

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7	0	7	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

스마트인덱스모

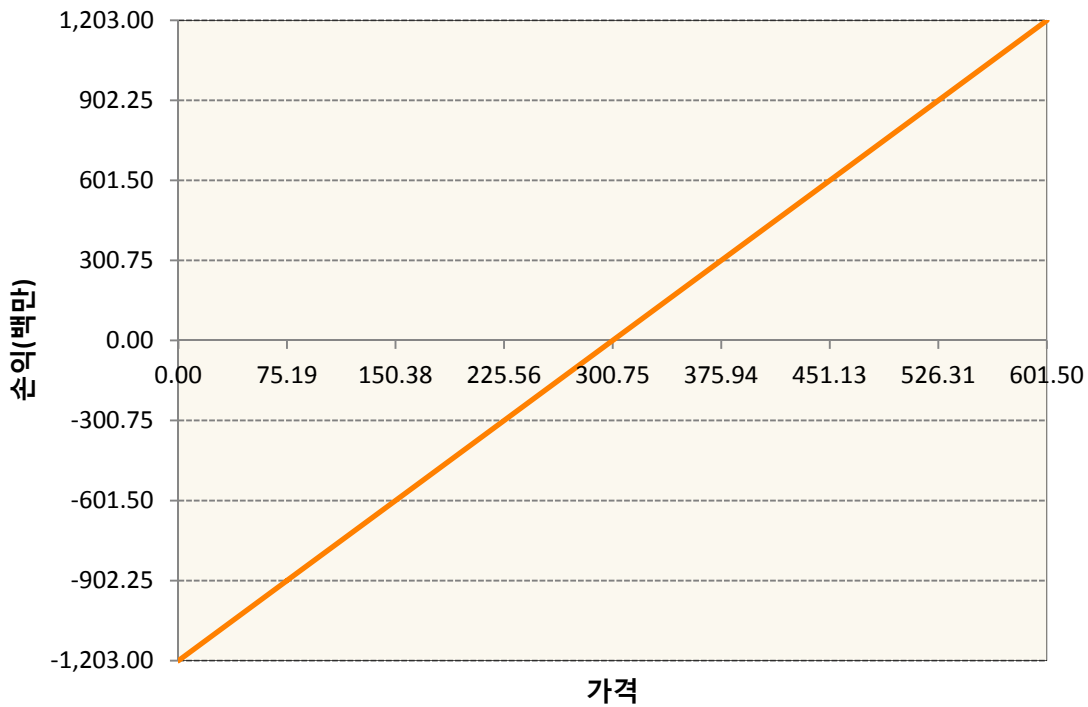
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,203	0	1,203	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,040	0	14,040	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180523

1,119

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

464

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,755	0	4,755	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180608

331

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

유로인덱스모(주식-파생형)

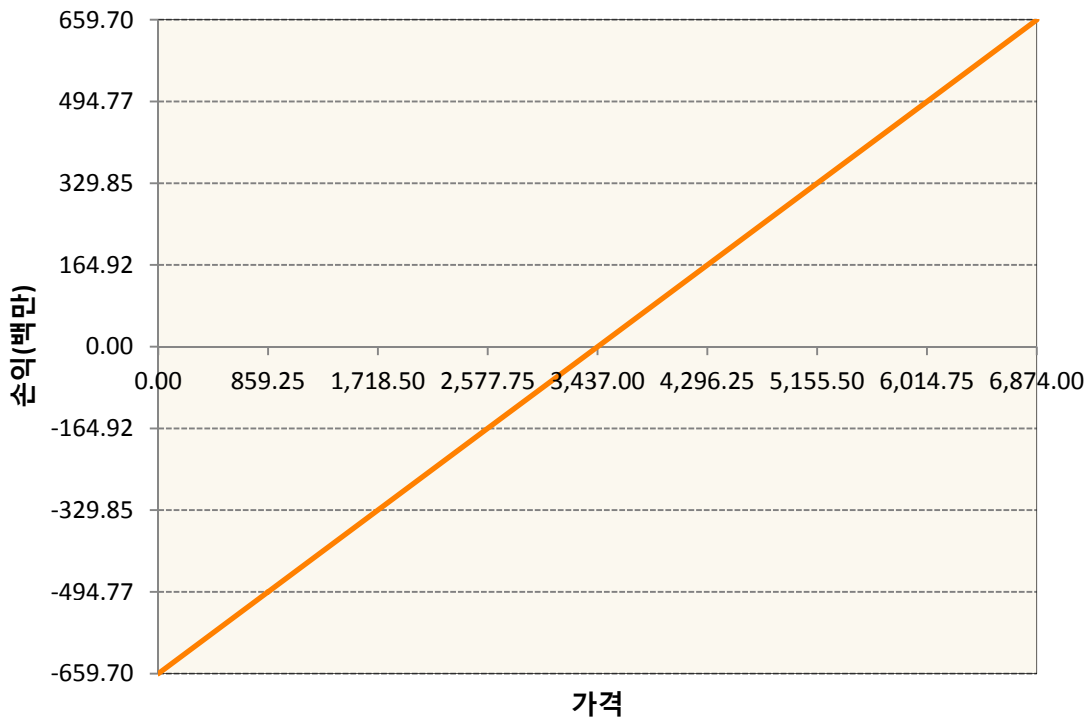
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	660	0	660	

2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	53
------	----------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

33

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

차이나인덱스모(주식-파생형)

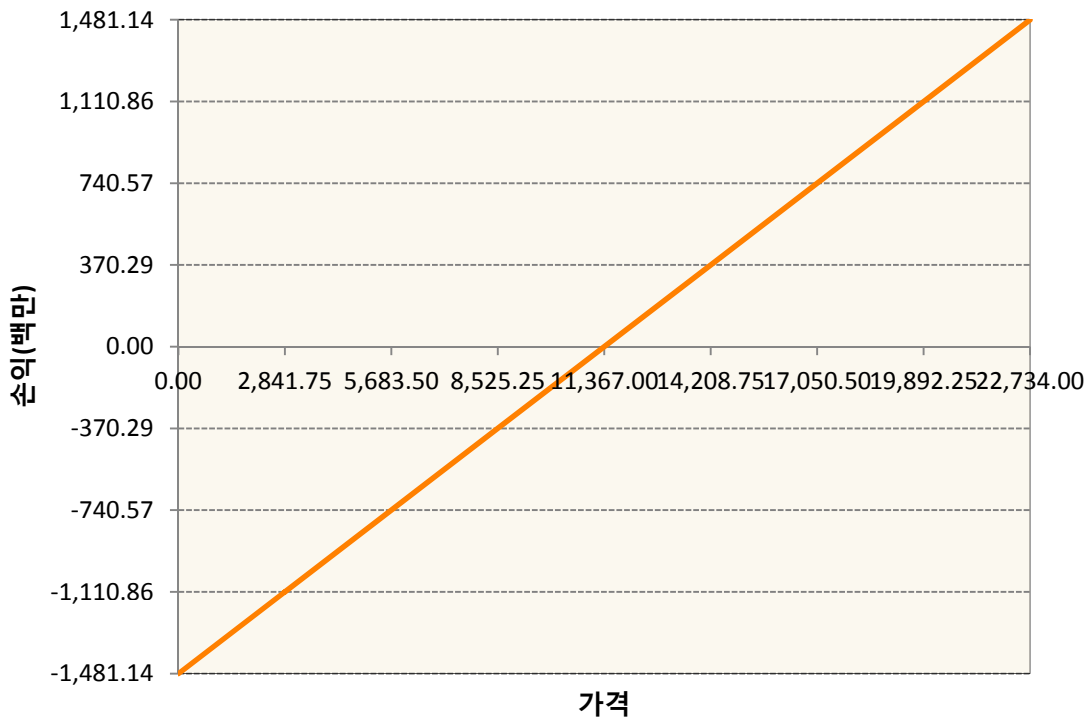
1. 계약금액

(단위:백만원)

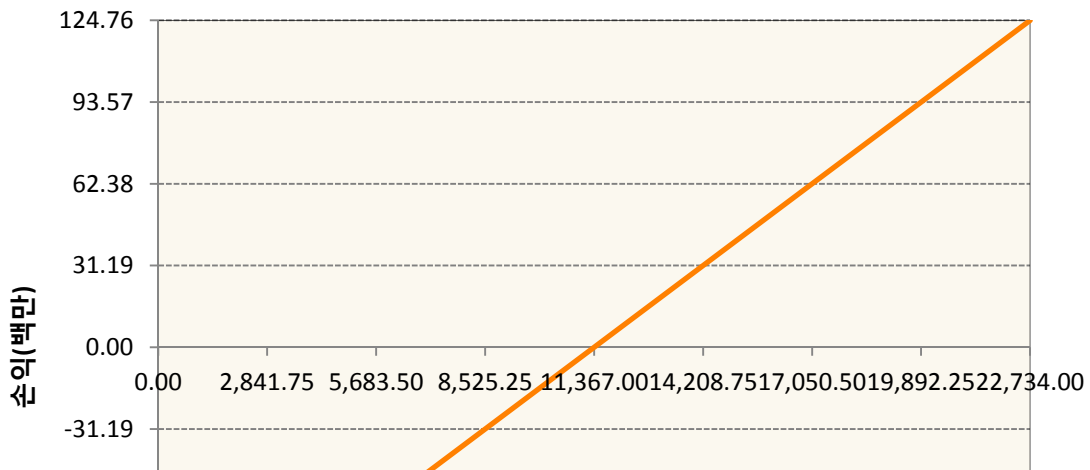
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,606	0	1,606	장내

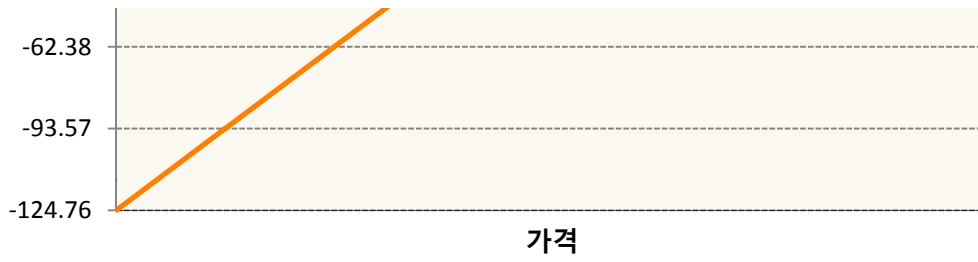
2. 만기시점의 손익구조

HCM8-HSCEI Futures Jun18



MHCM8-MINI H-SHR IDX FU Jun18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCM8	HSCEI Futures Jun18	118
MHCM8	MINI H-SHR IDX FU Jun18	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

115

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

커버드콜모(주식혼합-파생형)

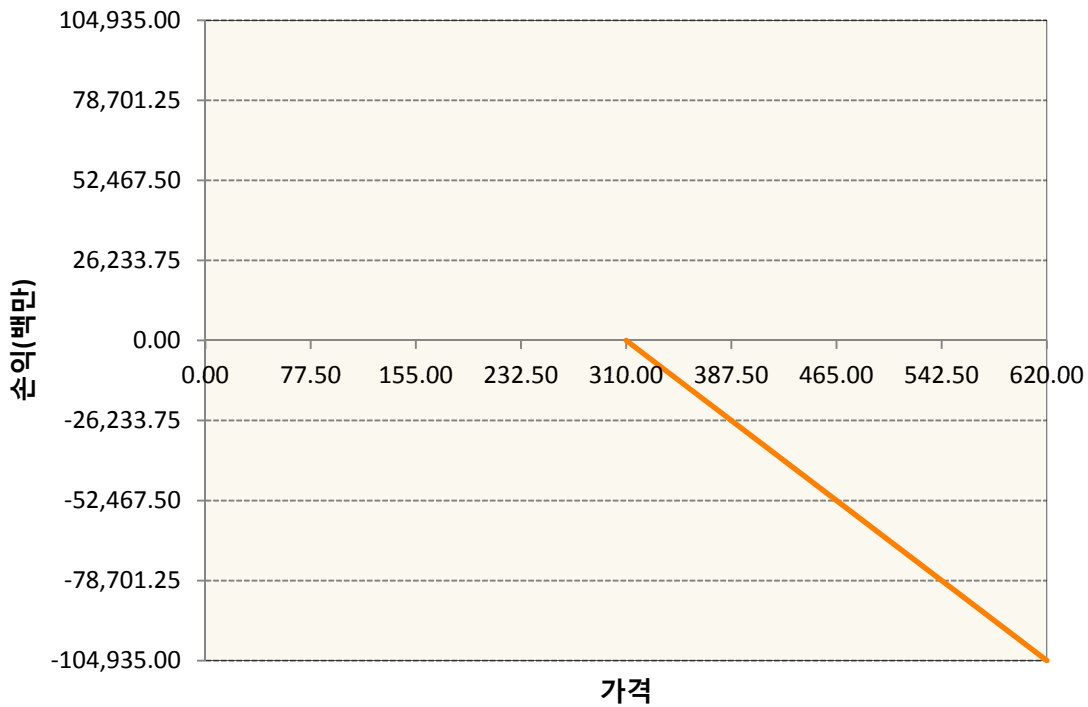
1. 계약금액

(단위:백만원)

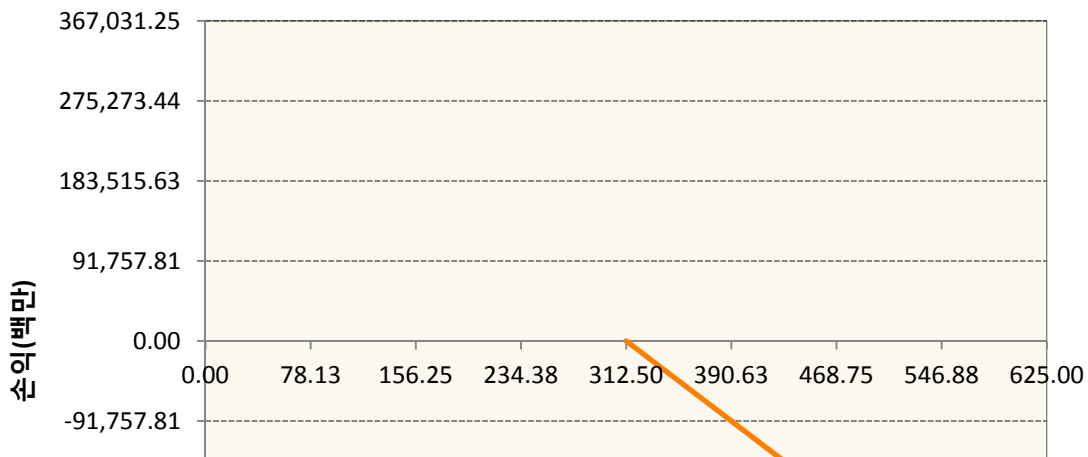
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	471,966	-471,966	장내

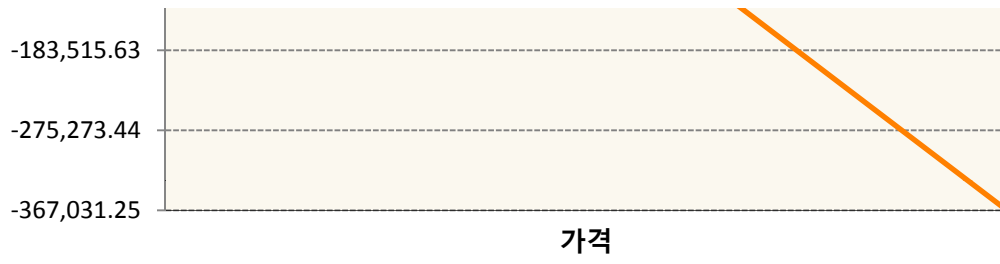
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310



KR4201N73125-2018-07 콜312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

19,111

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

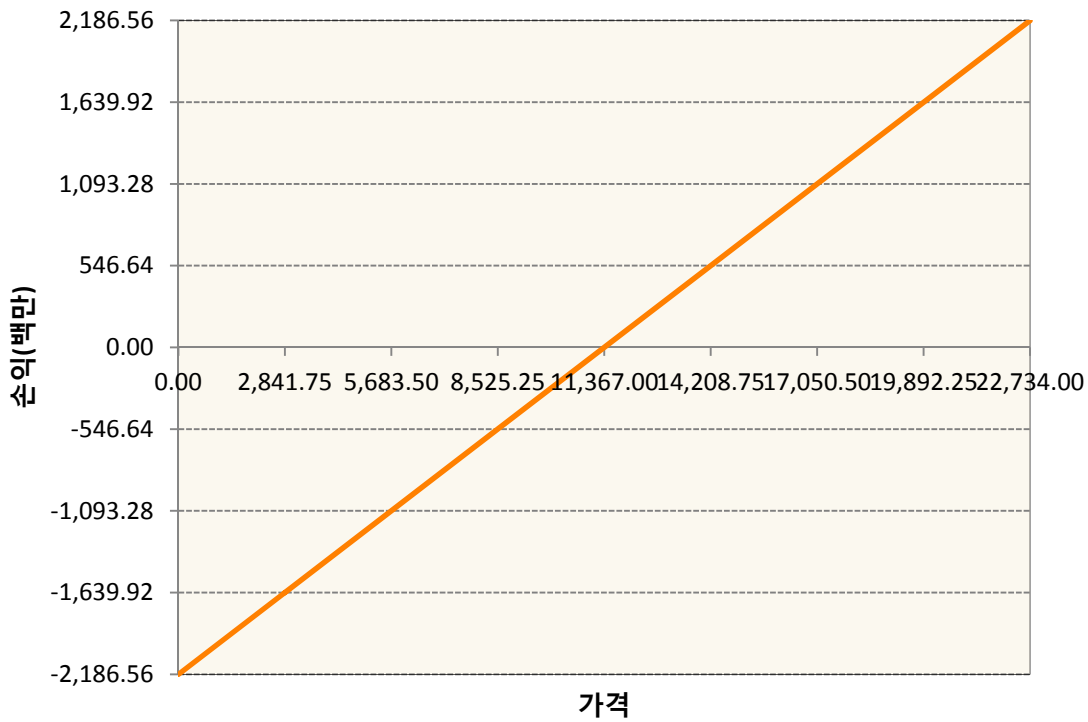
1. 계약금액

(단위:백만원)

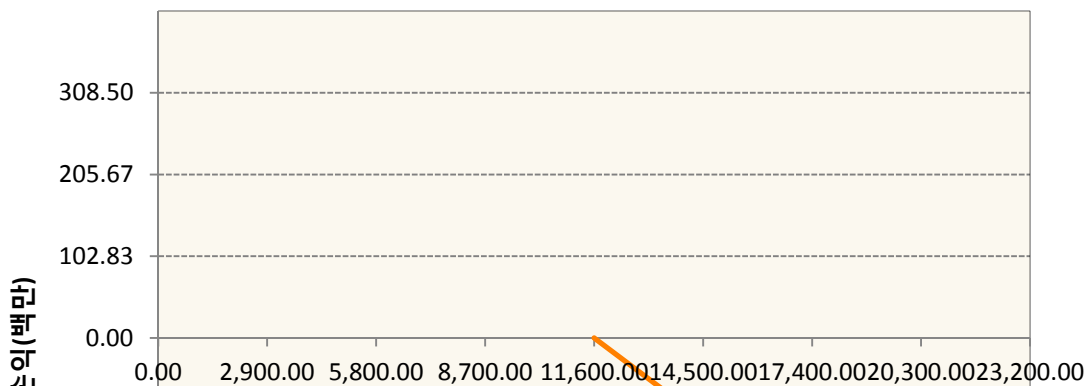
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,187	0	2,187	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,011	-6,011	장내

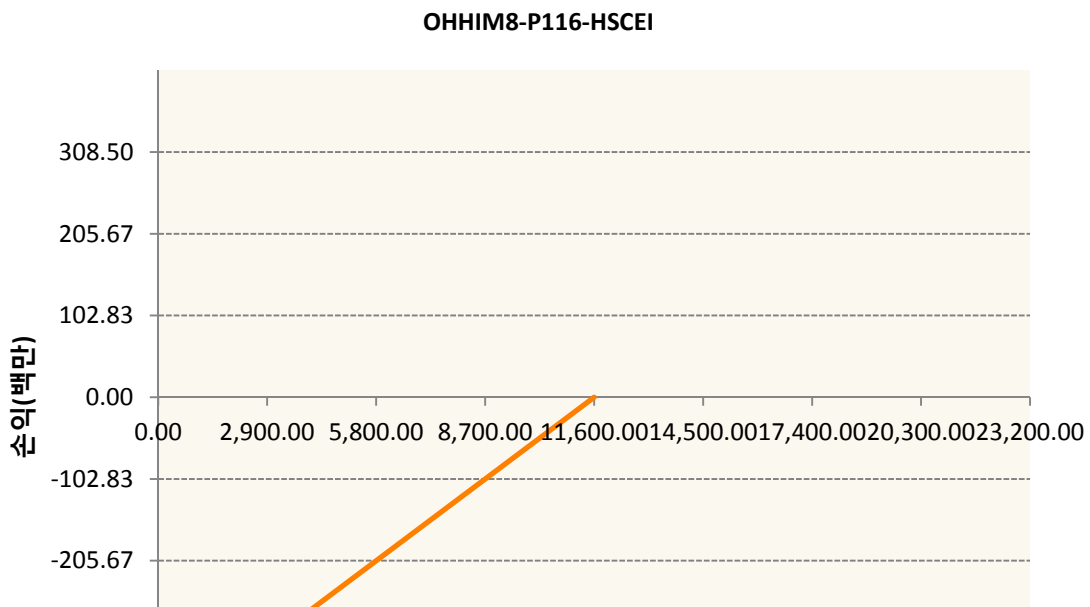
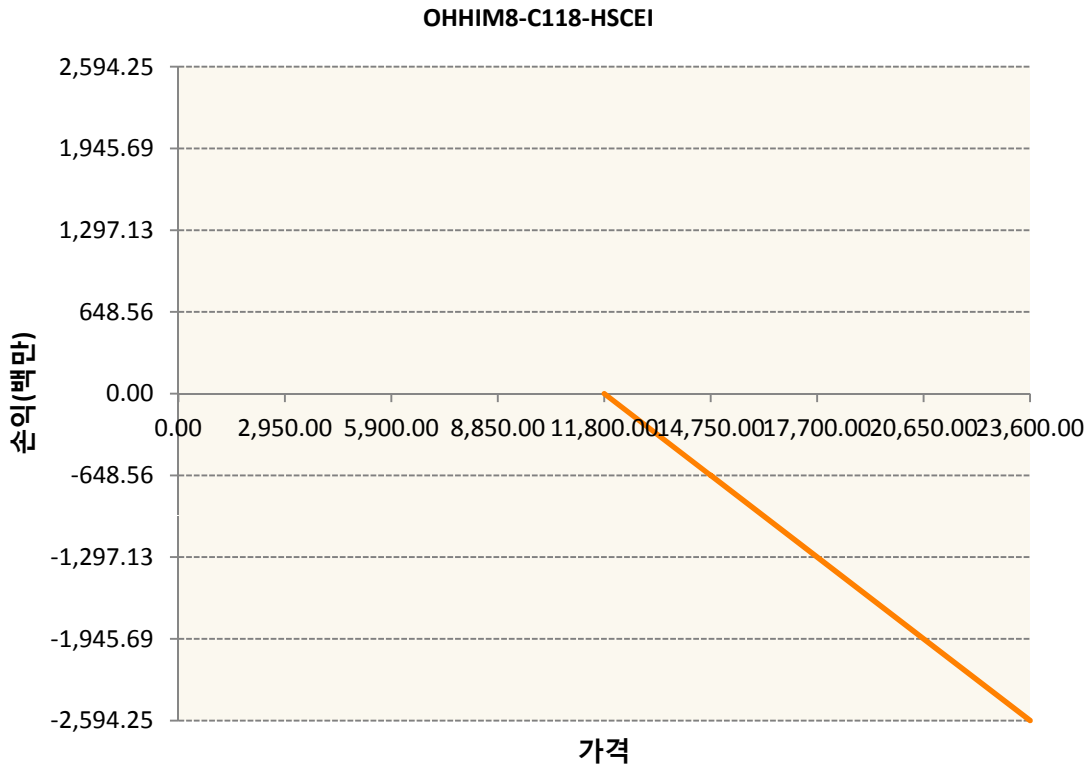
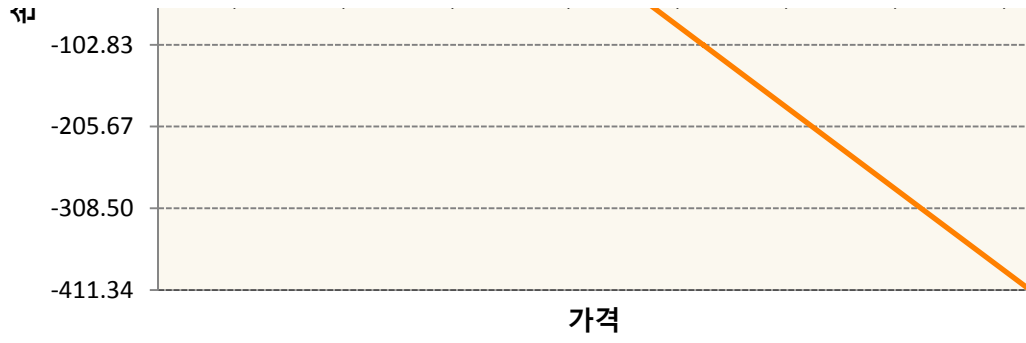
2. 만기시점의 손익구조

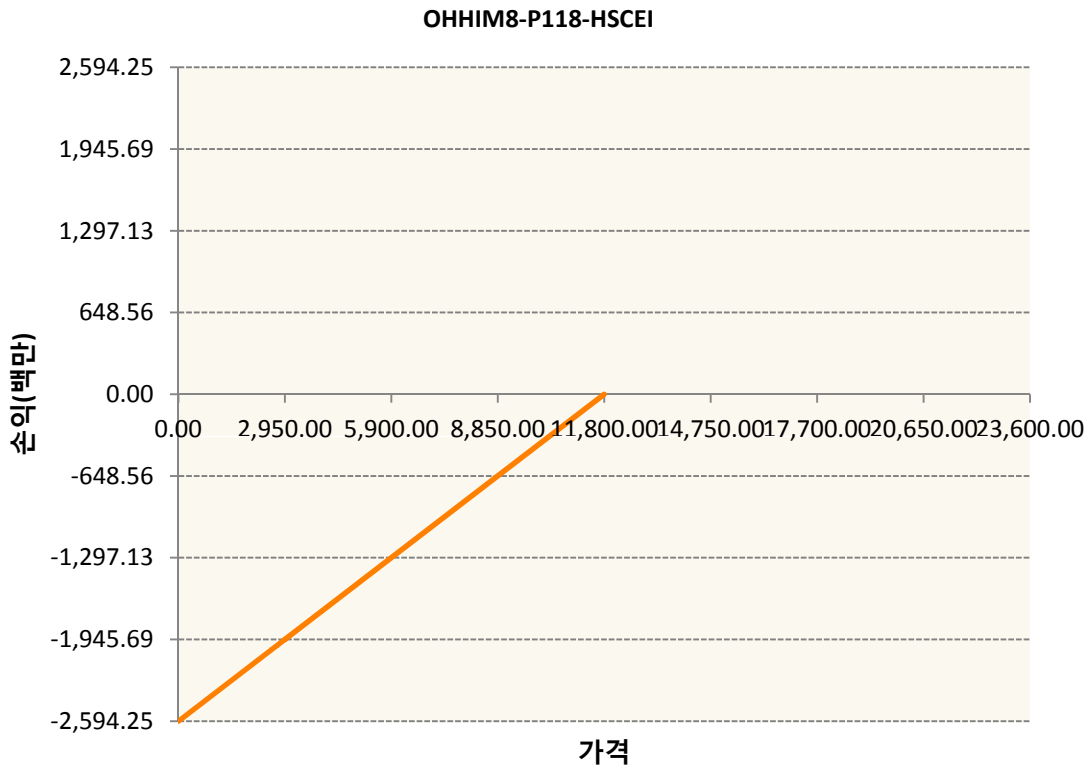
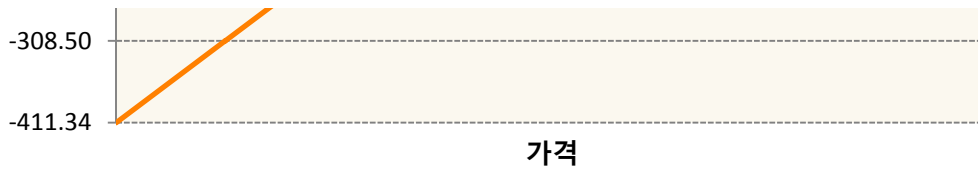
HCM8-HSCEI Futures Jun18



OHHIM8-C116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	175
OHHIM8-C1	HSCEI	33
OHHIM8-C1	HSCEI	208
OHHIM8-P1	HSCEI	33
OHHIM8-P1	HSCEI	208

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	588

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

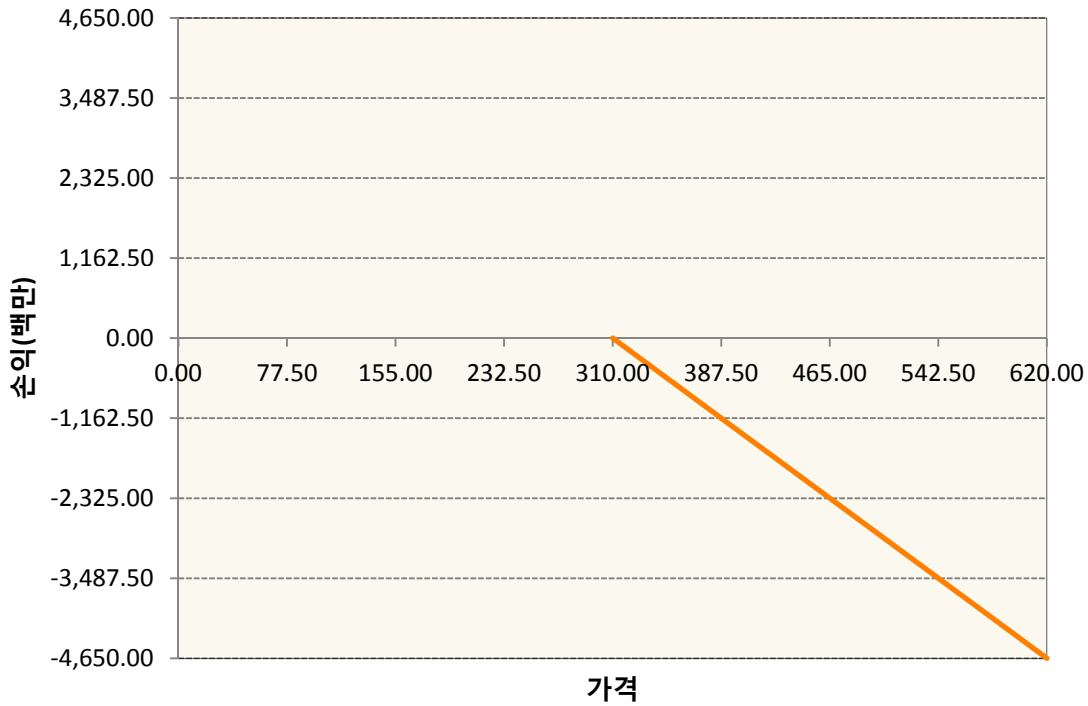
1. 계약금액

(단위:백만원)

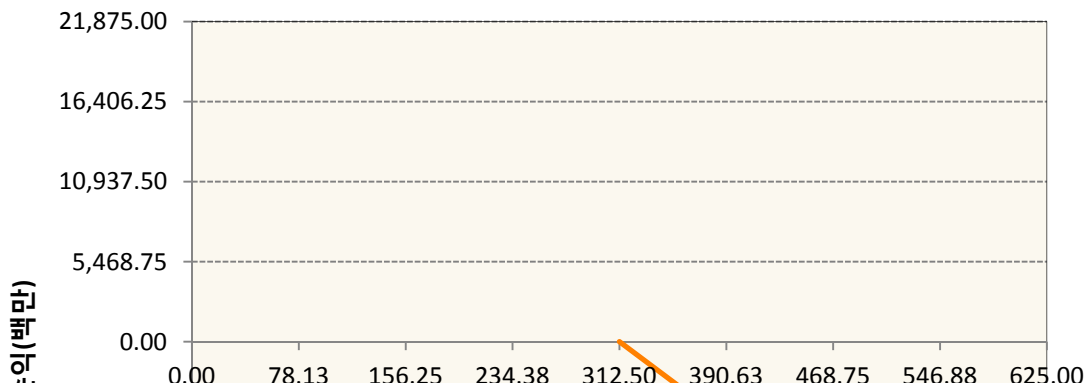
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,525	-26,525	장내

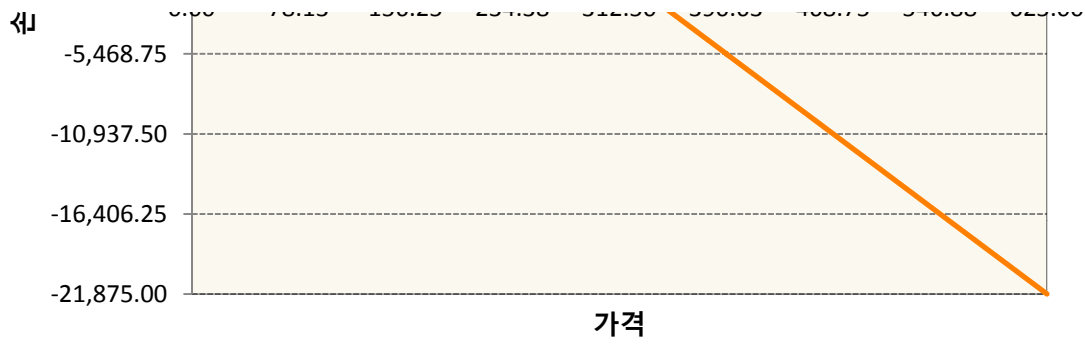
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310



KR4201N73125-2018-07 콜312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

4,964

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

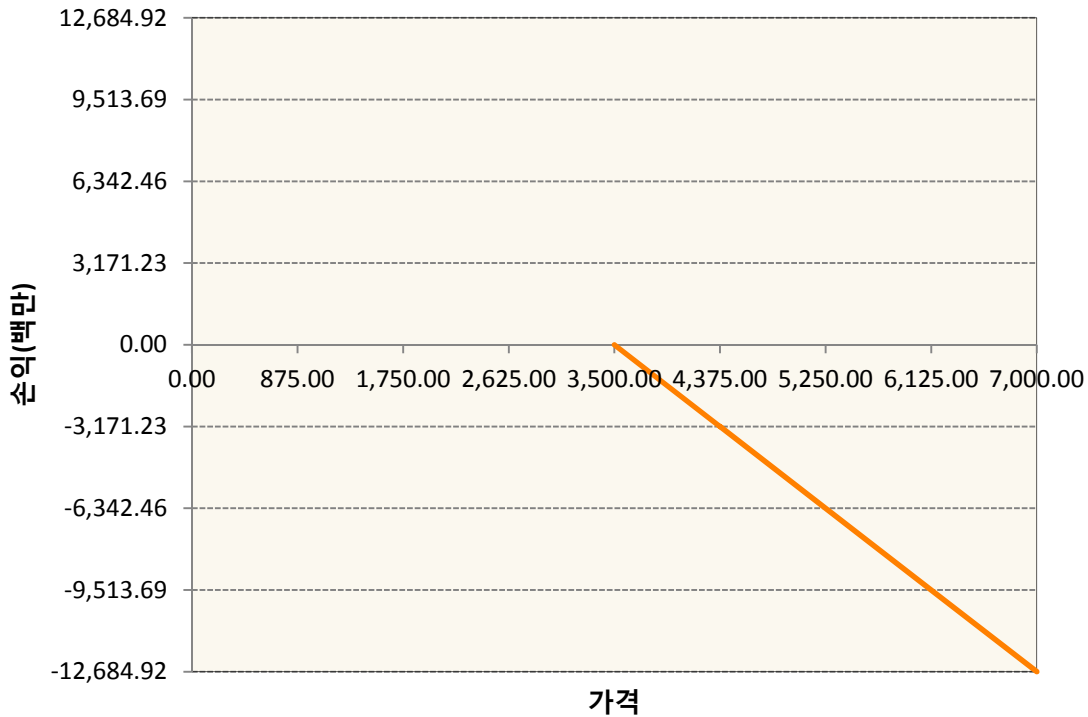
1. 계약금액

(단위:백만원)

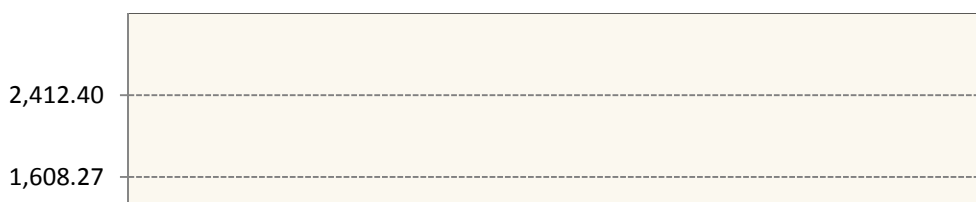
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,601	0	7,601	
누계	유가증권	스왑	43,903	0	43,903	장외
누계	유가증권	옵션	0	31,803	-31,803	장내
누계	지수	스왑	51,408	0	51,408	장외

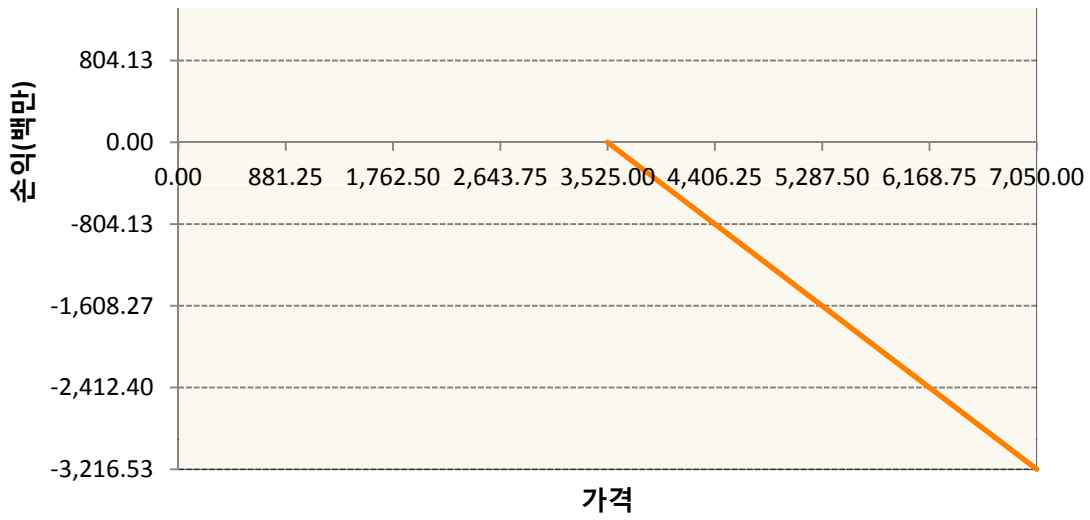
2. 만기시점의 손익구조

OESXN8-C3500-EURO STOXX 50

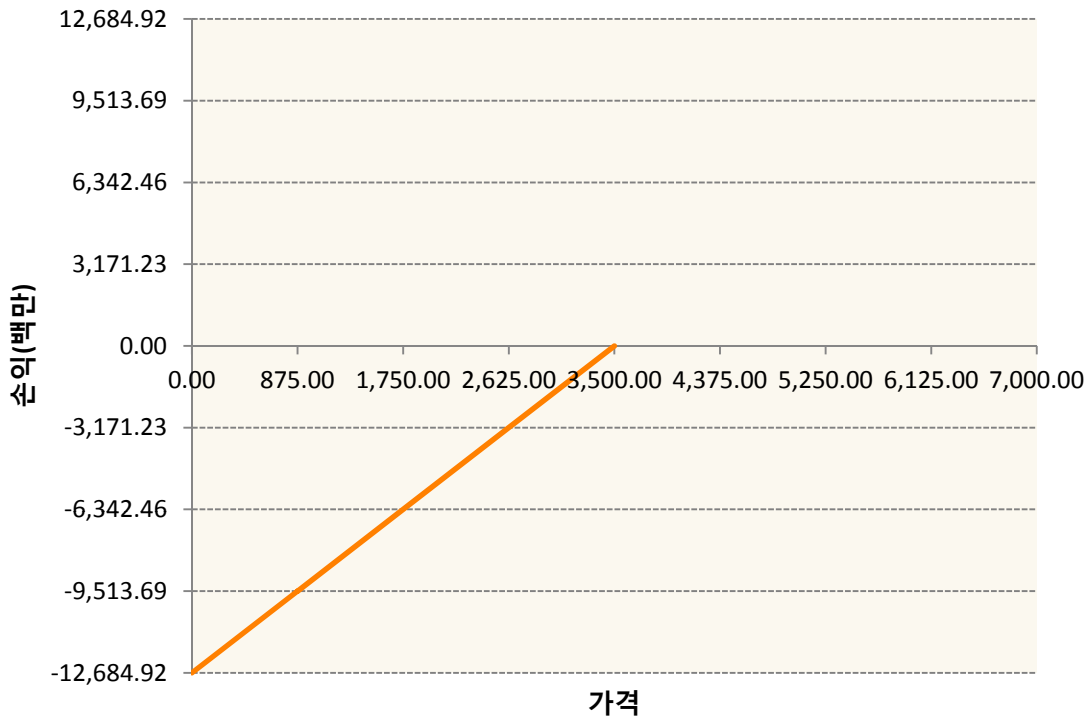


OESXN8-C3525-EURO STOXX 50

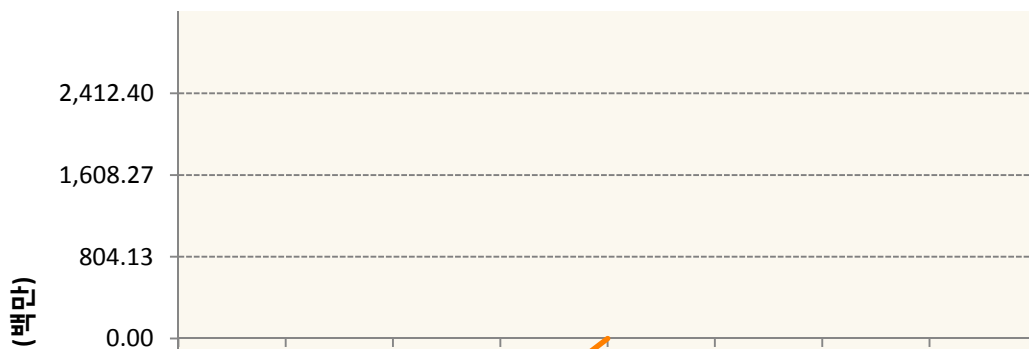


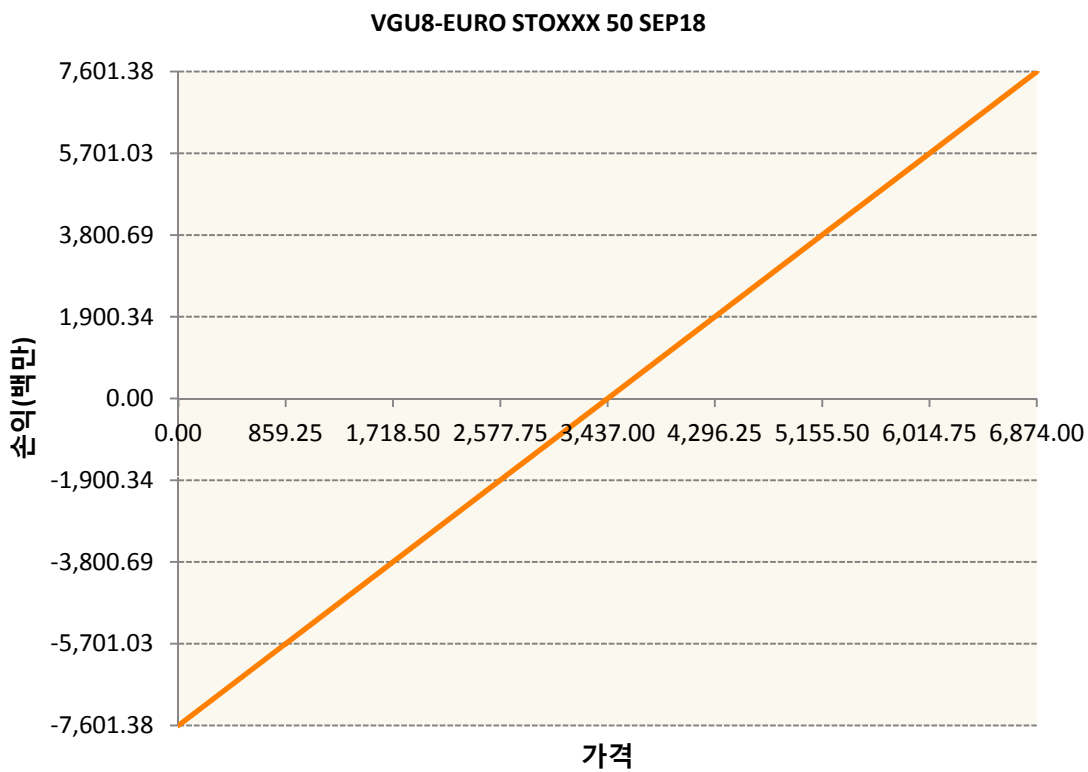
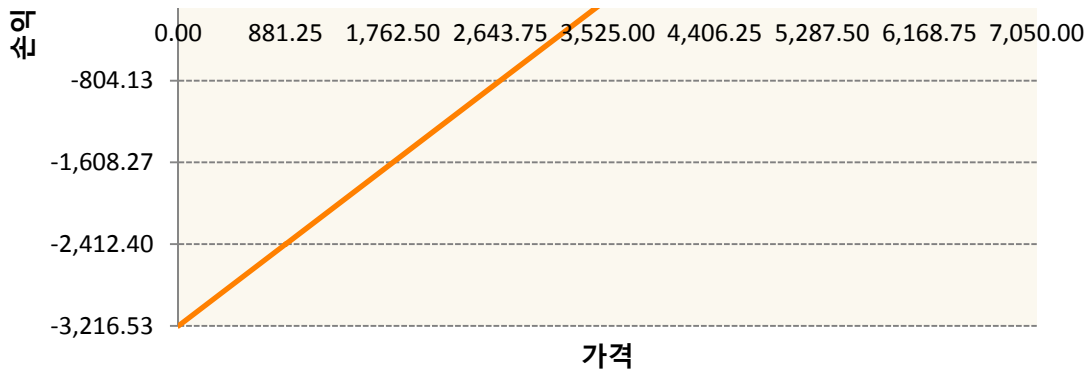


OESXN8-P3500-EURO STOXX 50



OESXN8-P3525-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569		3
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		3
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		1,015
OESXN8-C3! EURO STOXX 50		257
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		1,015
OESXN8-P3! EURO STOXX 50		257
VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18		608

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

ETF스마트레버리지목표전환형8호

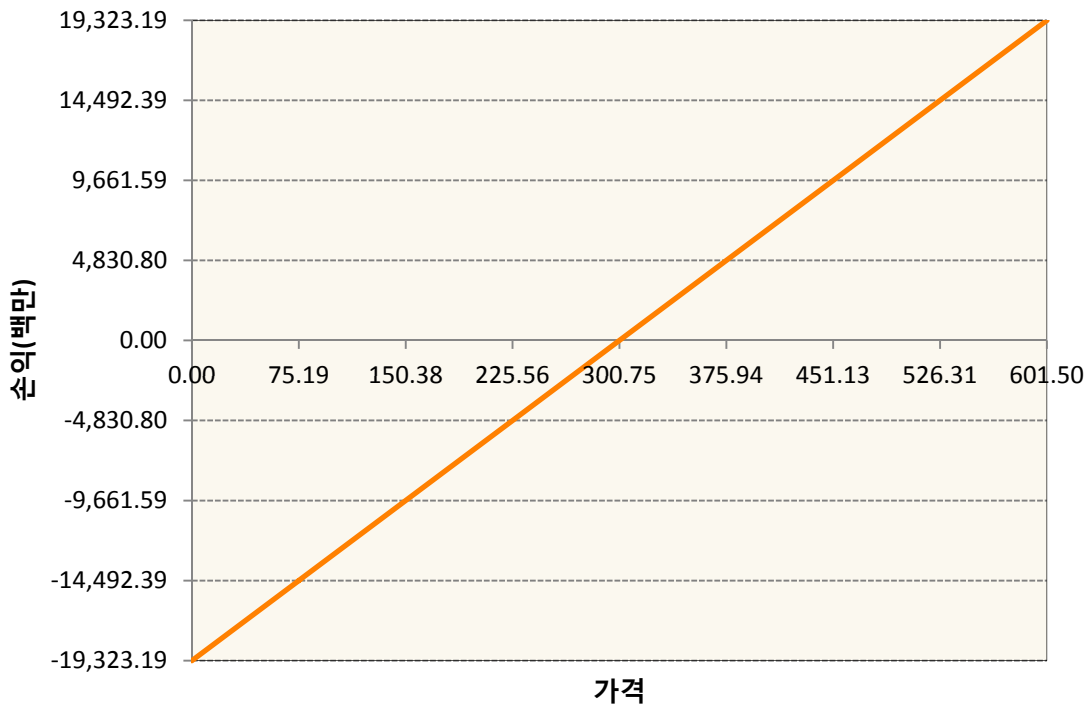
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	19,323	0	19,323	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

ETF스마트레버리지목표전환형9호

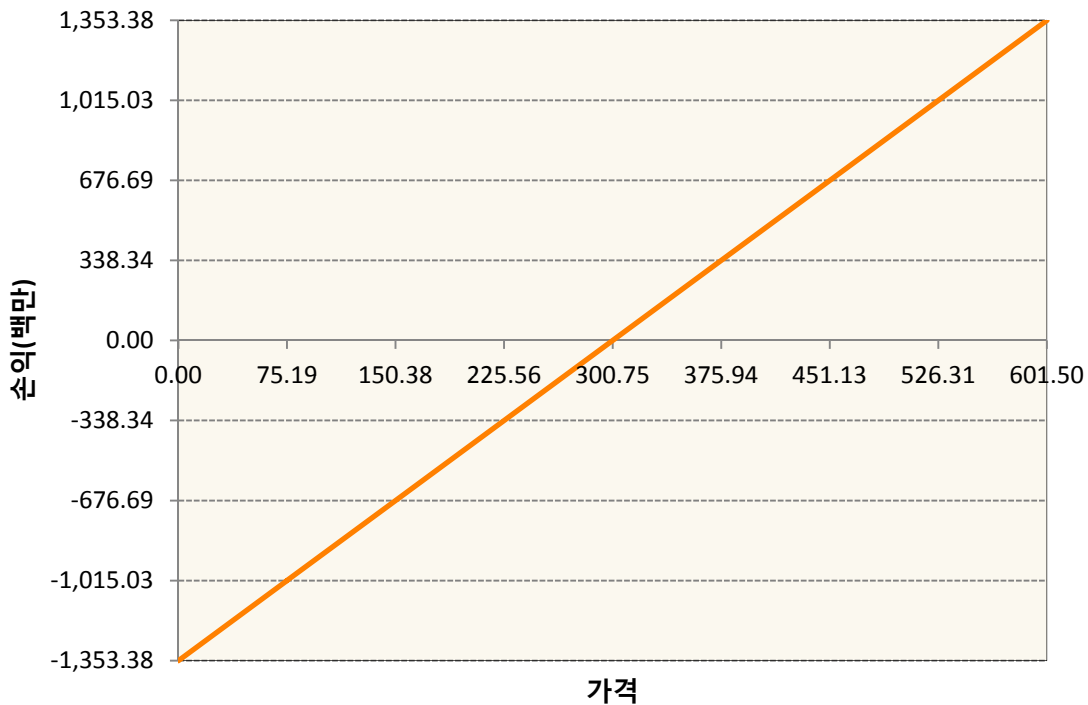
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,353	0	1,353	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

ETF스마트레버리지목표전환형10

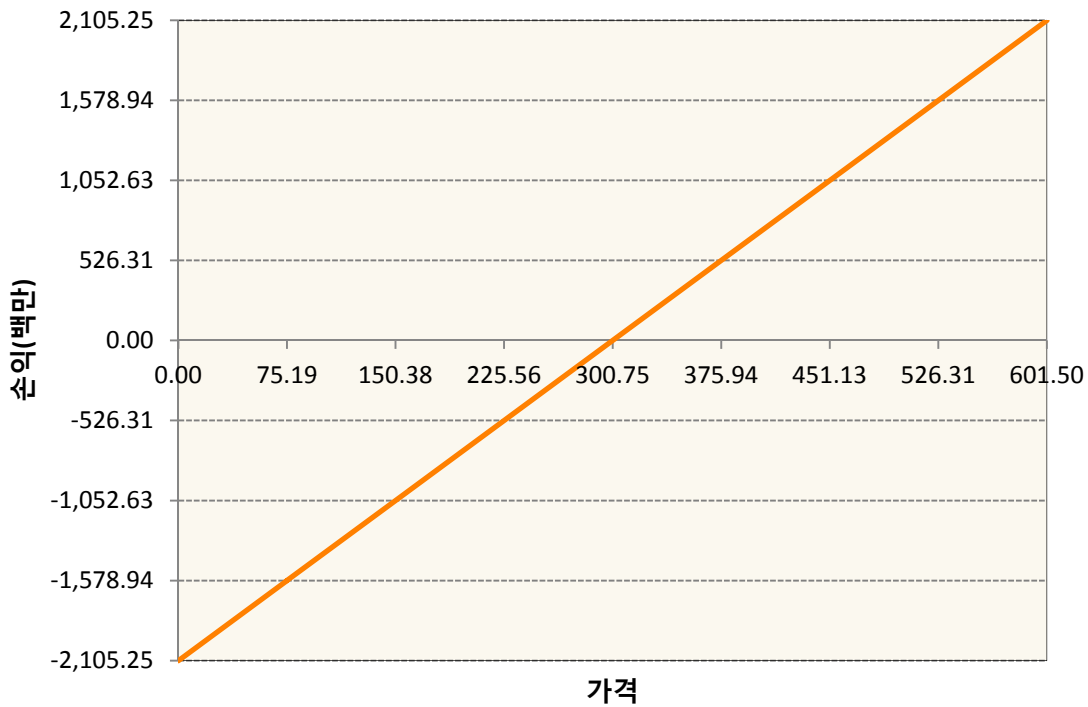
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,105	0	2,105	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

스마트KRX300인덱스1호(주식-파)

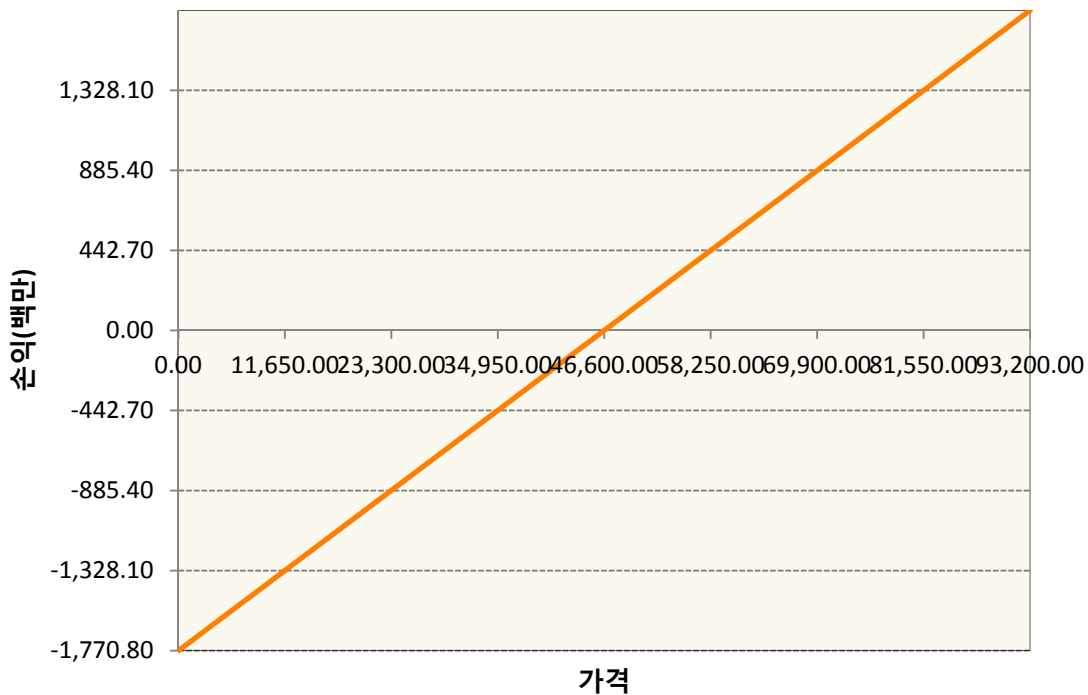
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,771	0	1,771	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111N70007-2018-07 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

스마트KRX300인덱스목표전환형1

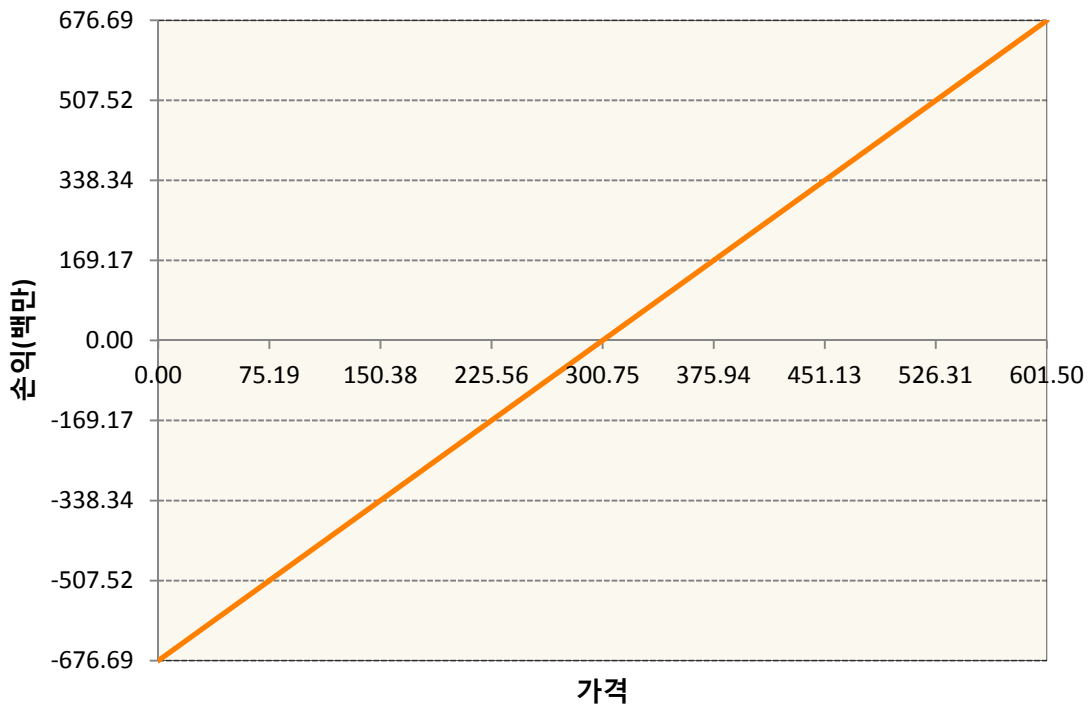
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	677	0	677	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간

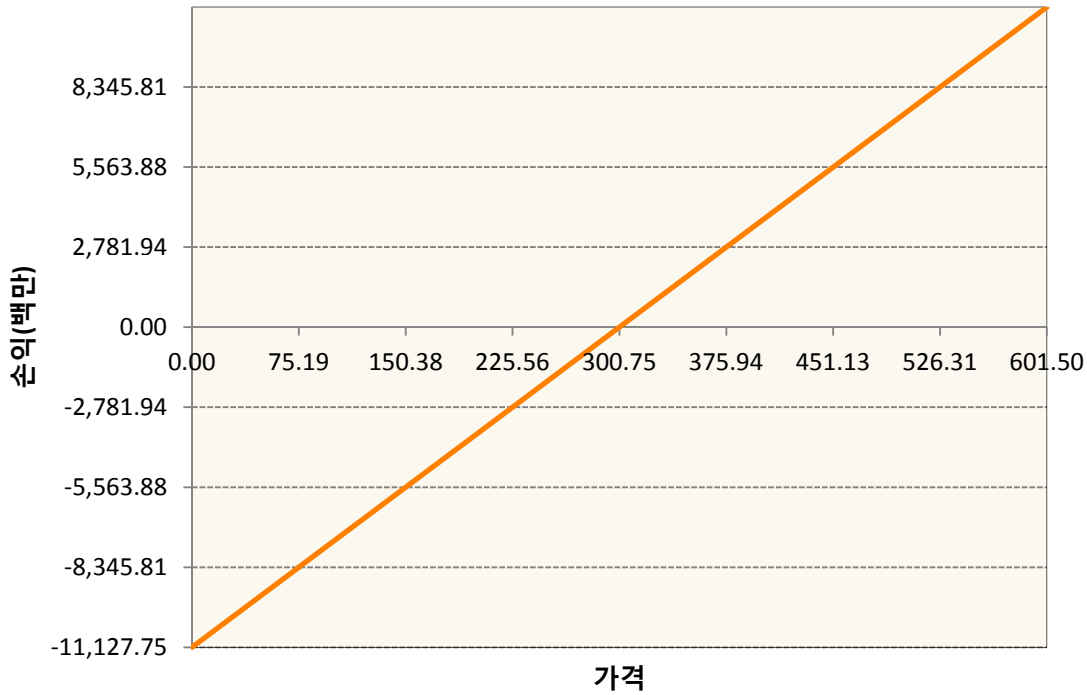
1. 계약금액

(단위:백만원)

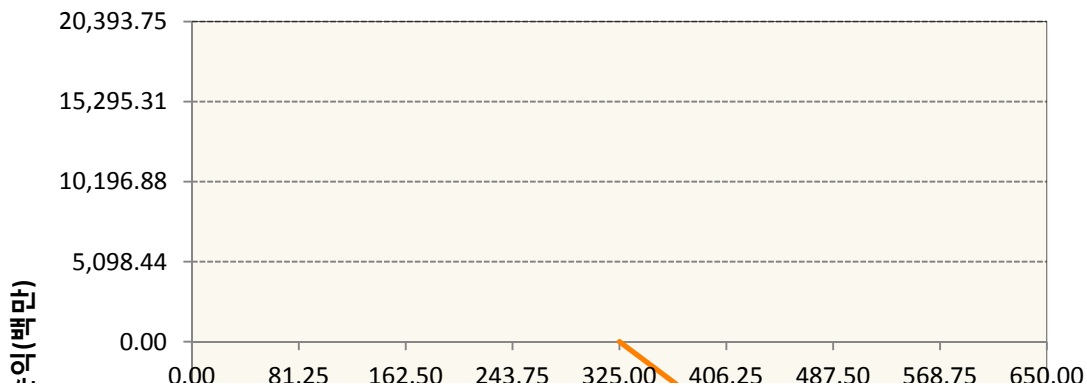
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	303	0	303	장내
신규	유가증권	옵션	0	569	-569	장내
누계	유가증권	선물	11,128	0	11,128	장내
누계	유가증권	옵션	0	20,394	-20,394	장내

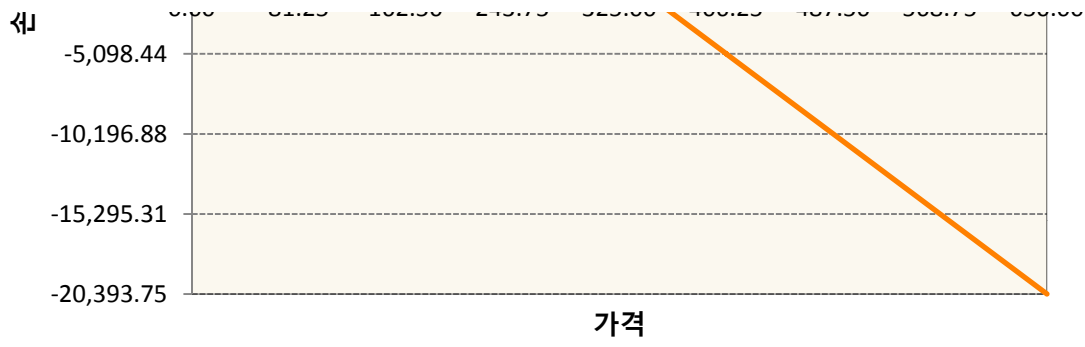
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4201N73257-2018-07 콜325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

1,102

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

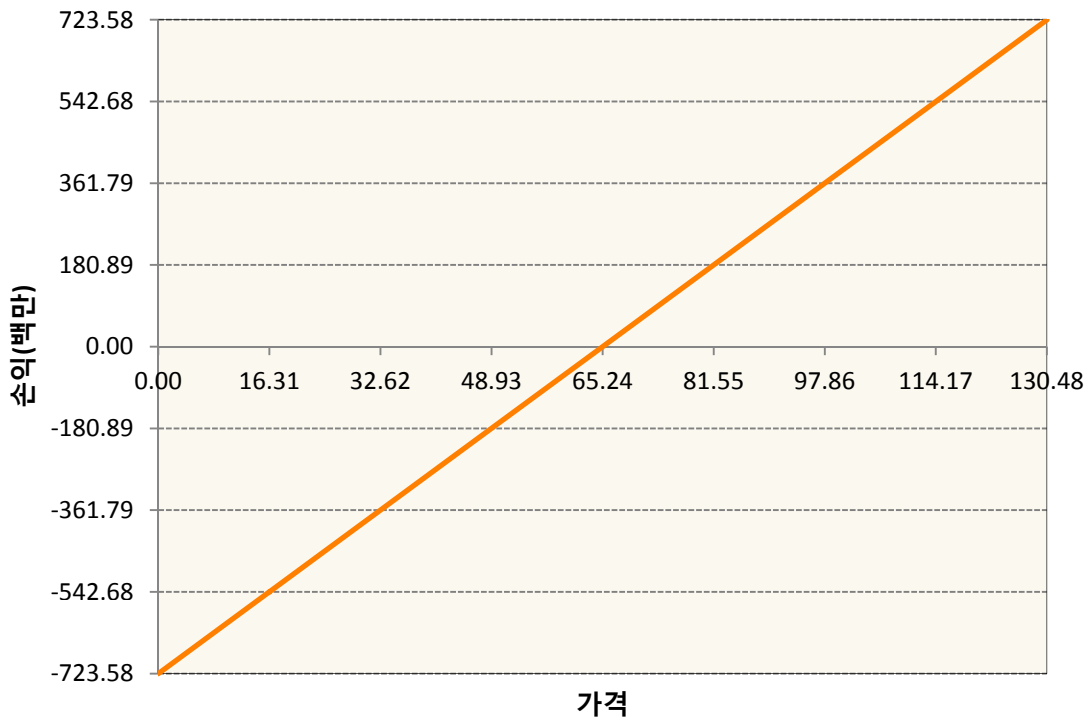
1. 계약금액

(단위:백만원)

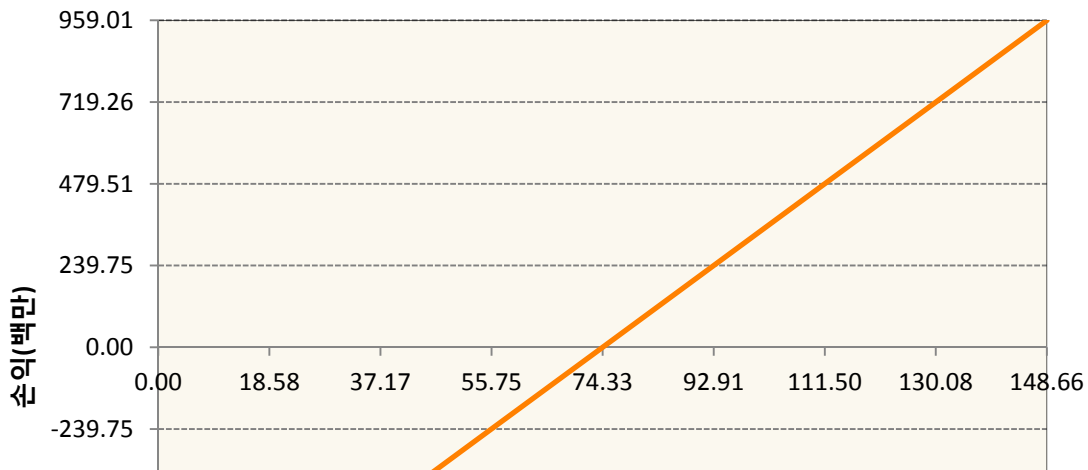
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,717	611	3,107	

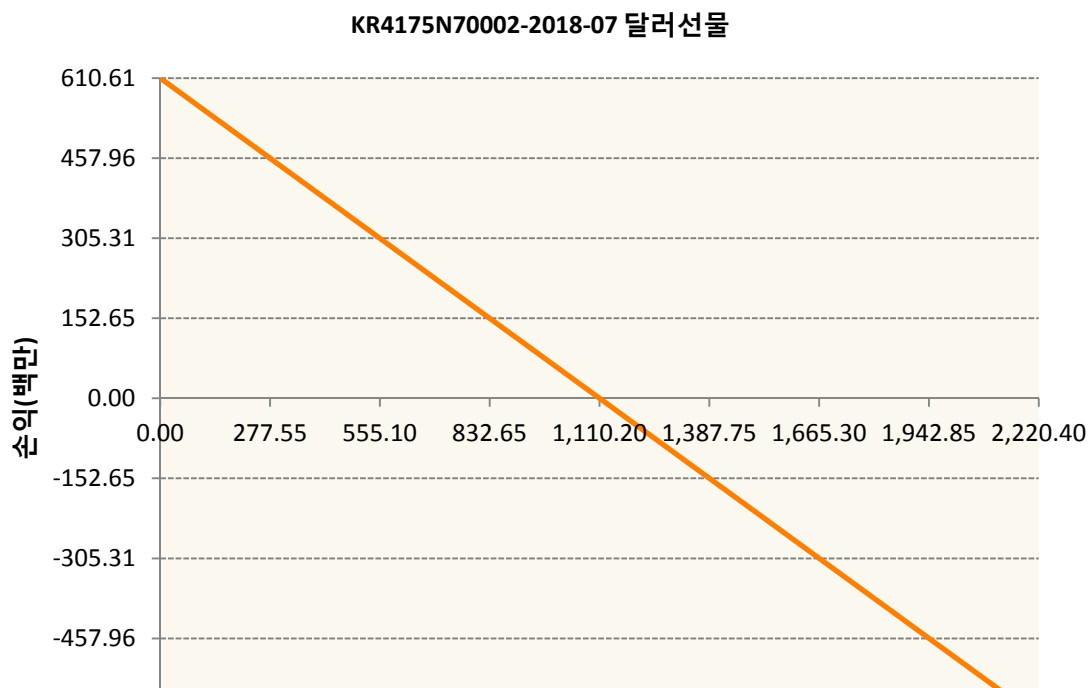
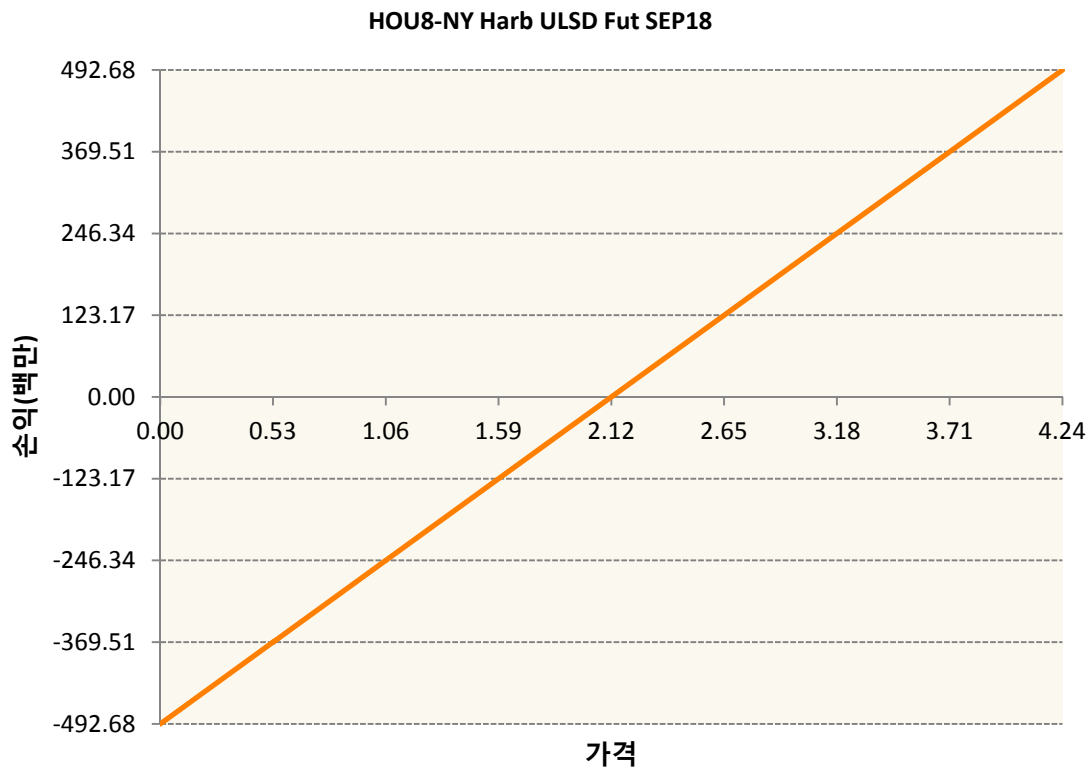
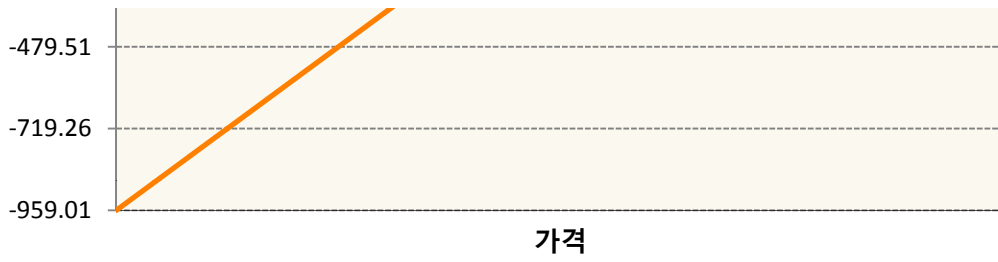
2. 만기시점의 손익구조

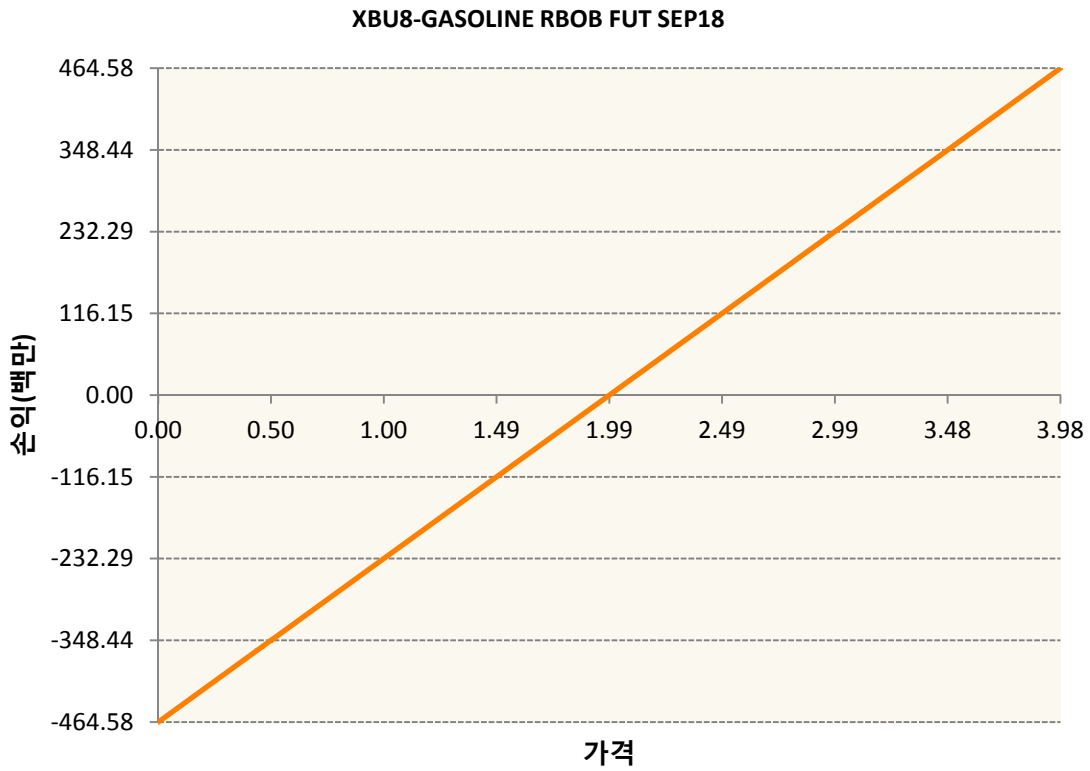
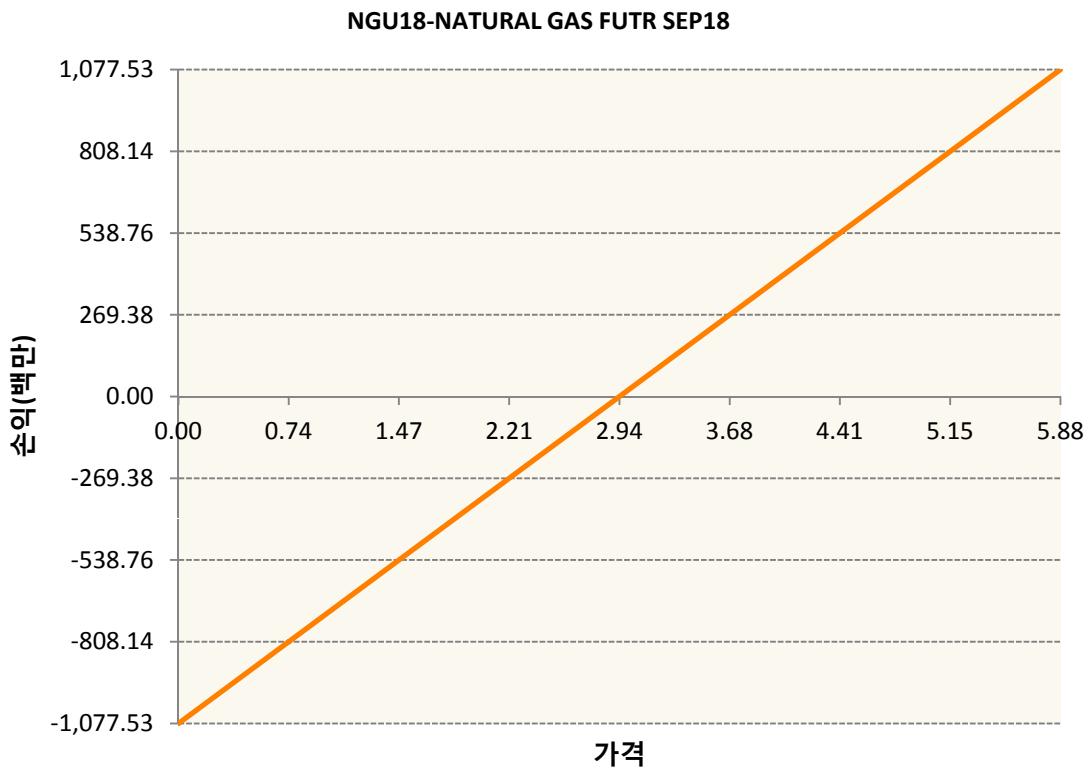
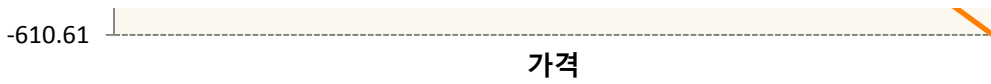
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	58
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	77
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	39
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	86
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

437

공시일	2018-06-22
기준일	2018-06-21

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

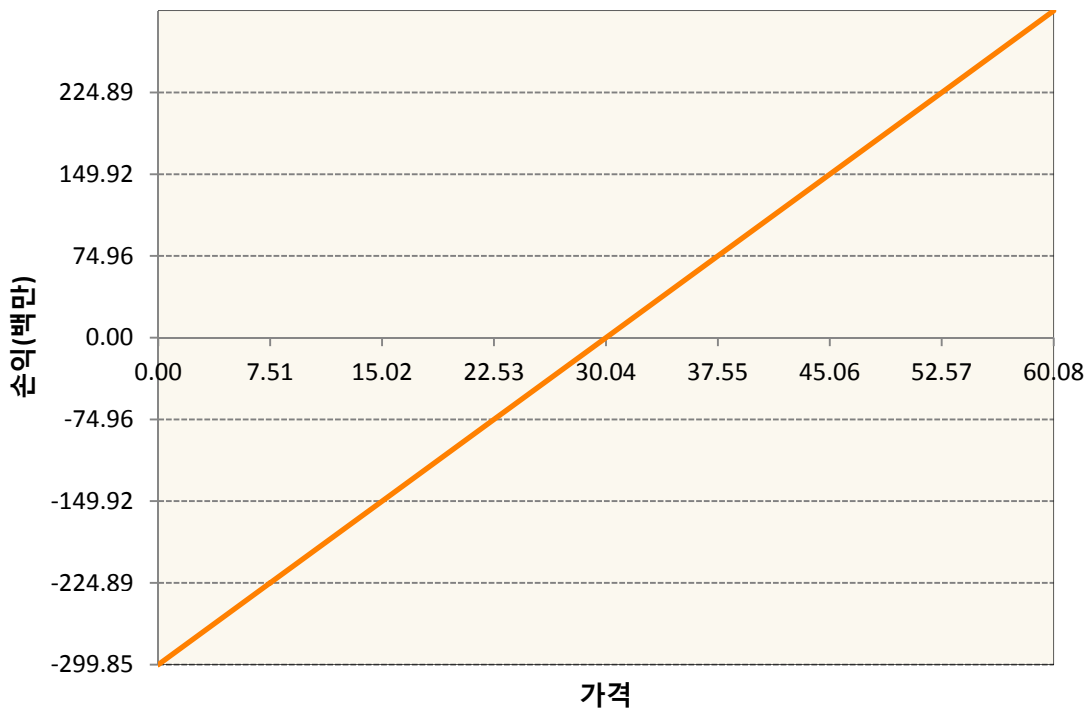
1. 계약금액

(단위:백만원)

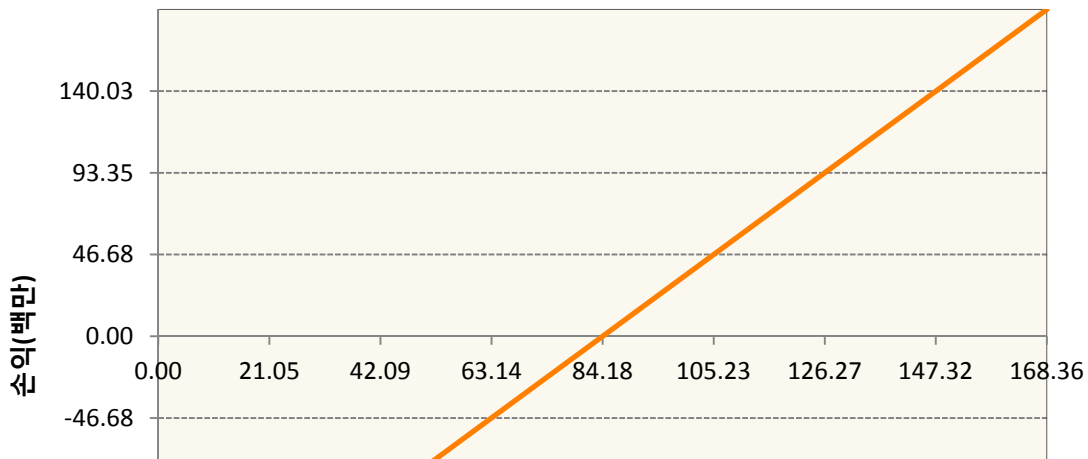
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,781	167	3,614	

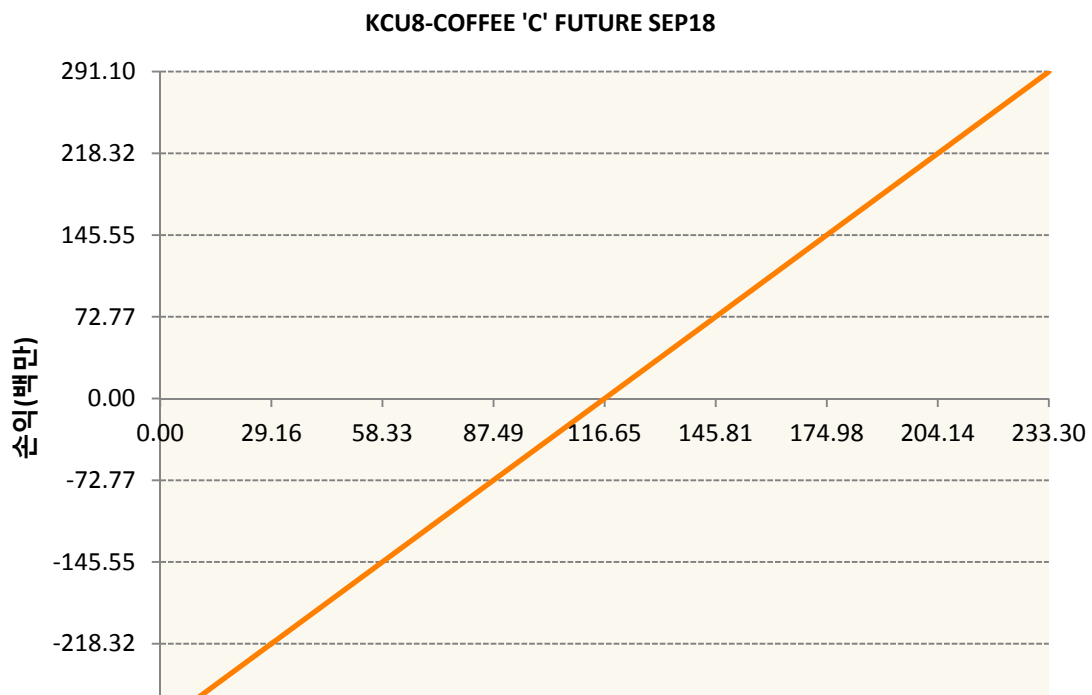
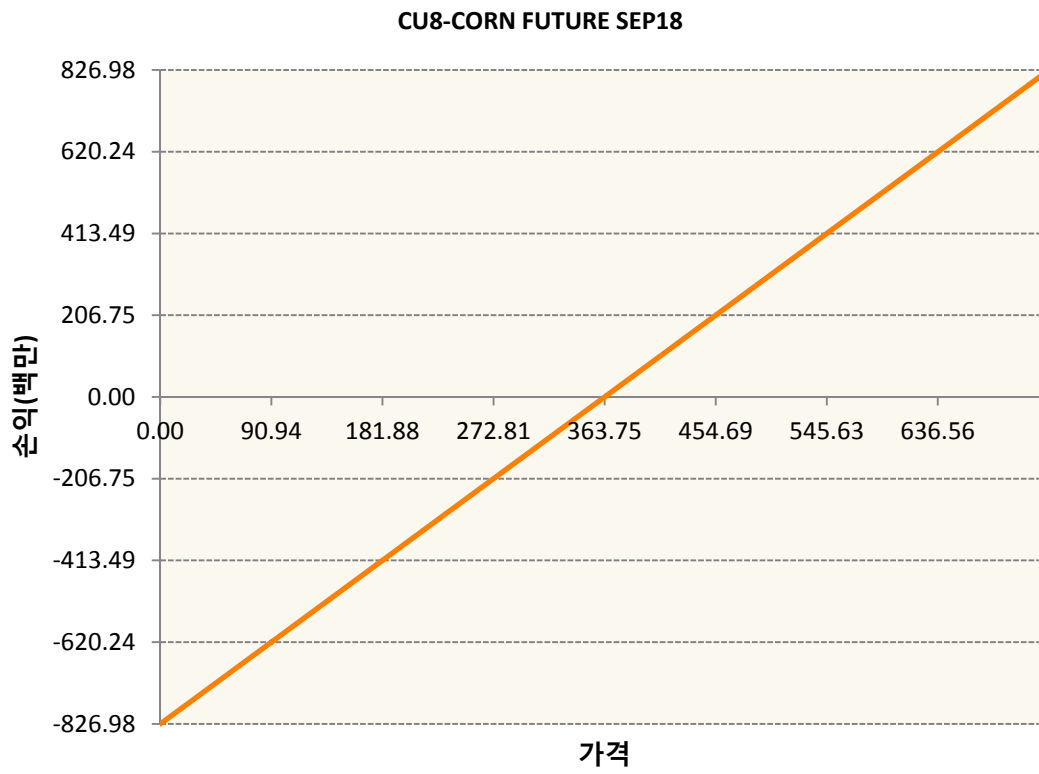
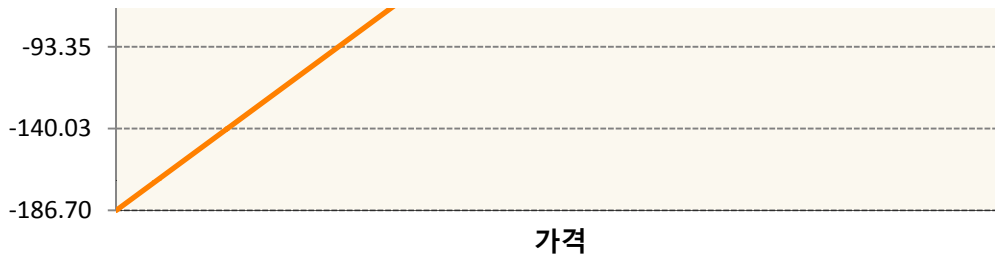
2. 만기시점의 손익구조

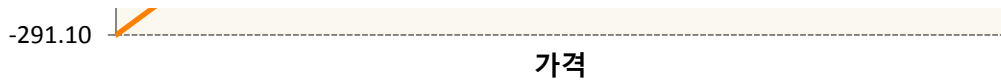
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



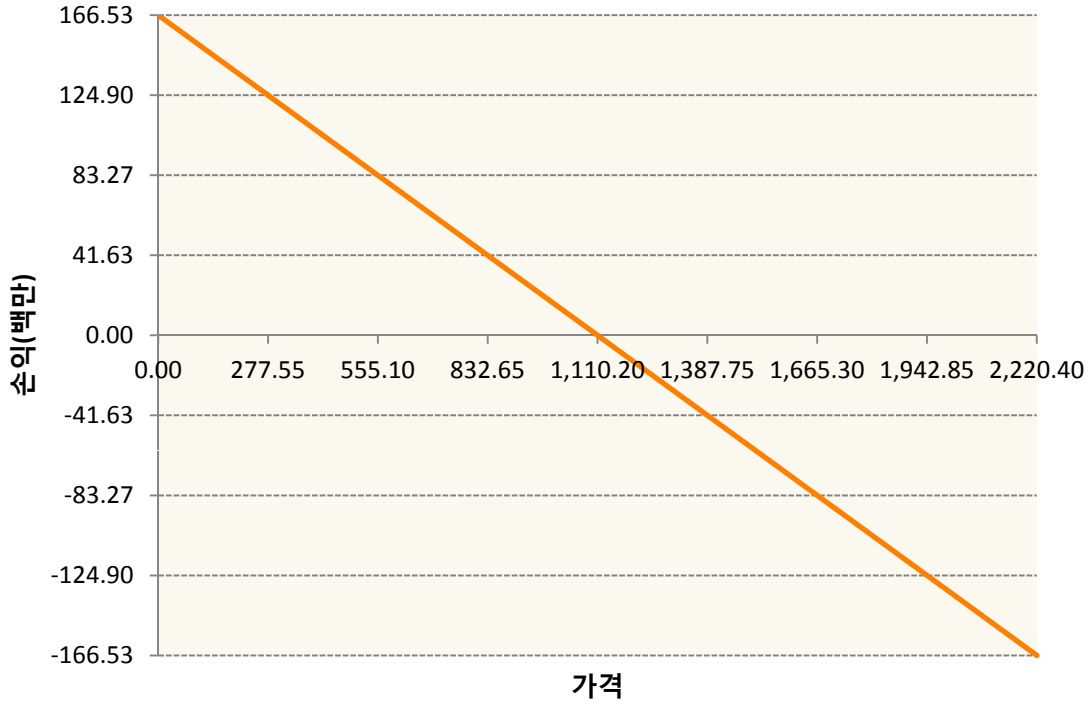
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



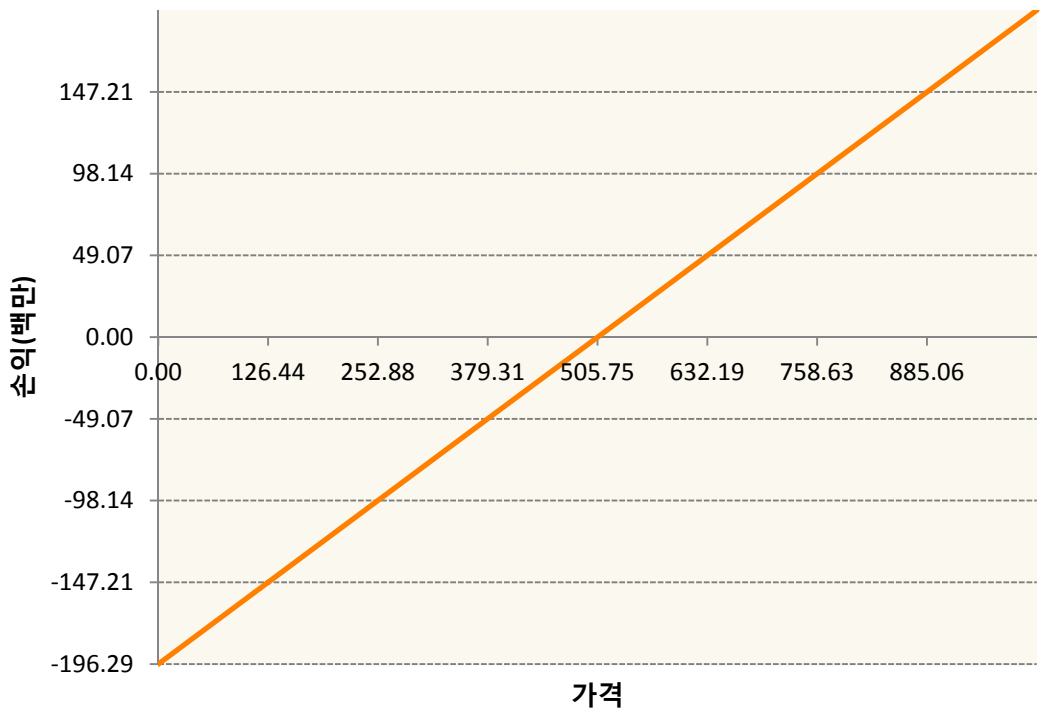




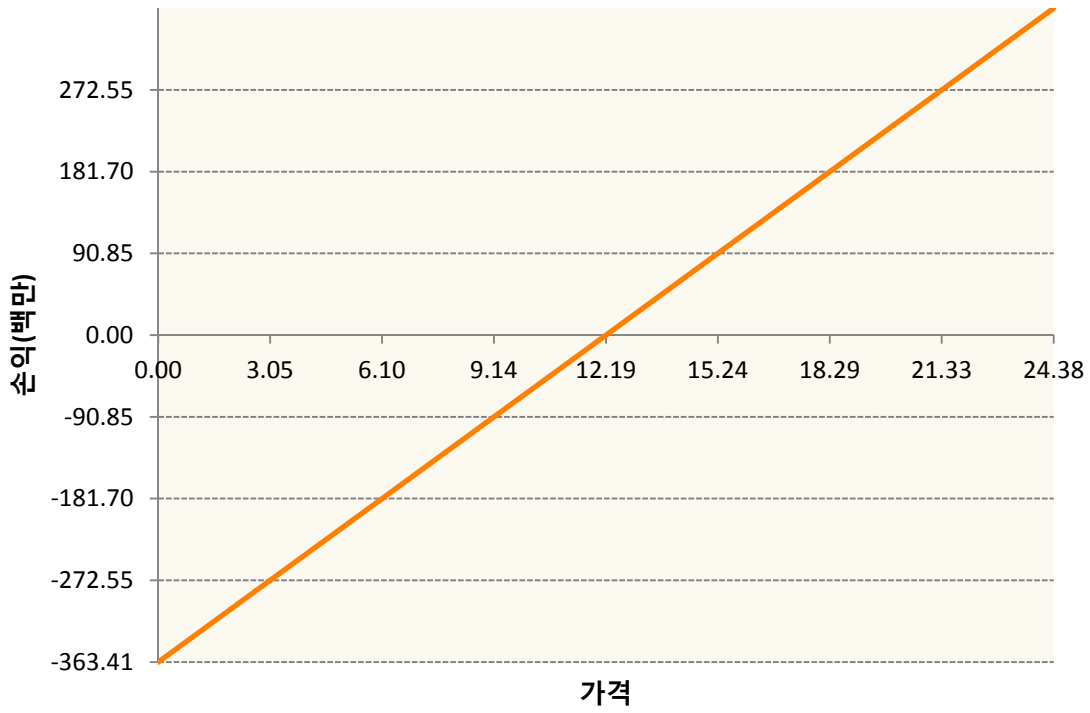
KR4175N70002-2018-07 달러선물



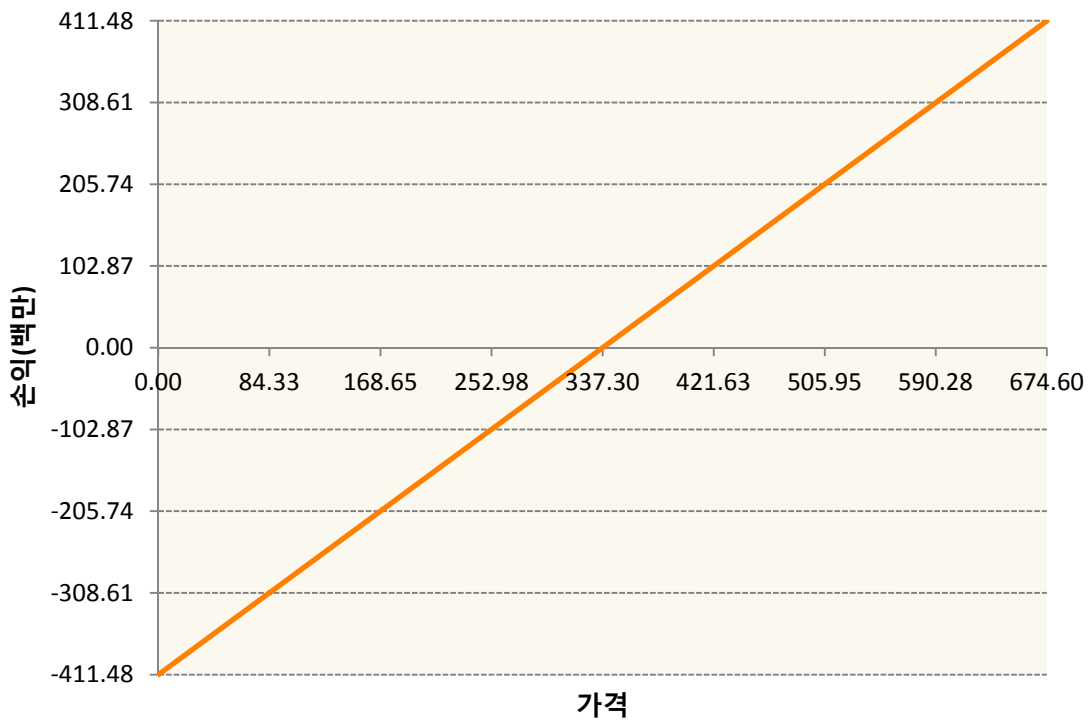
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

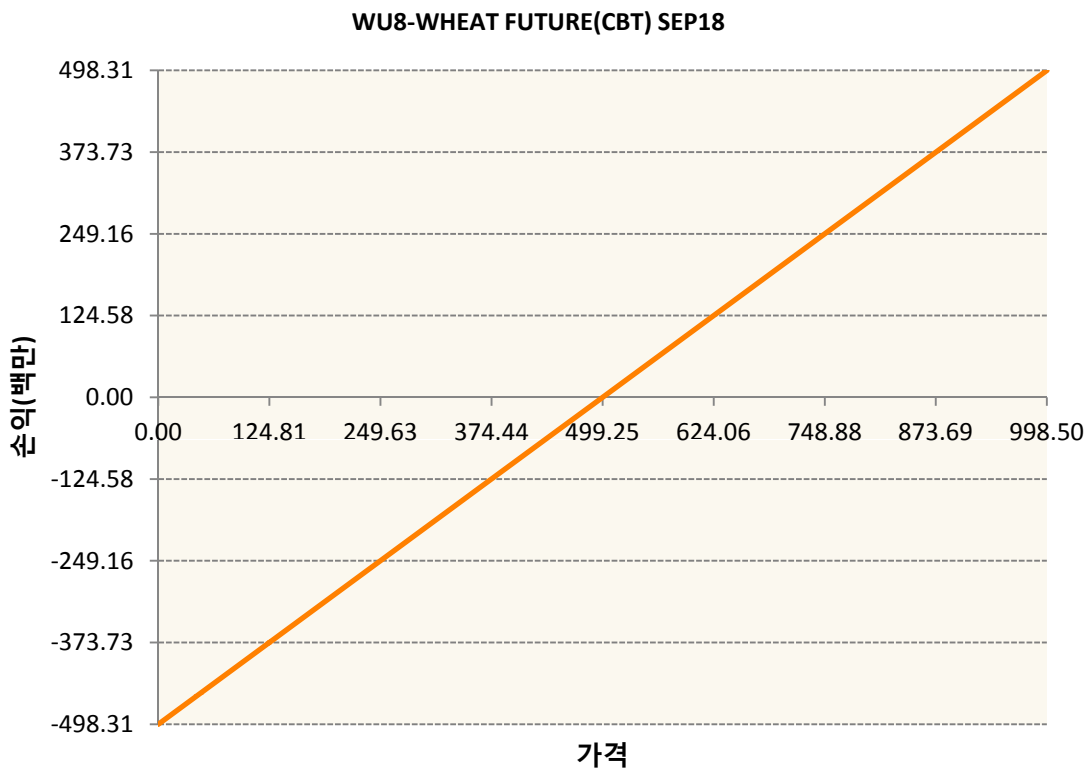
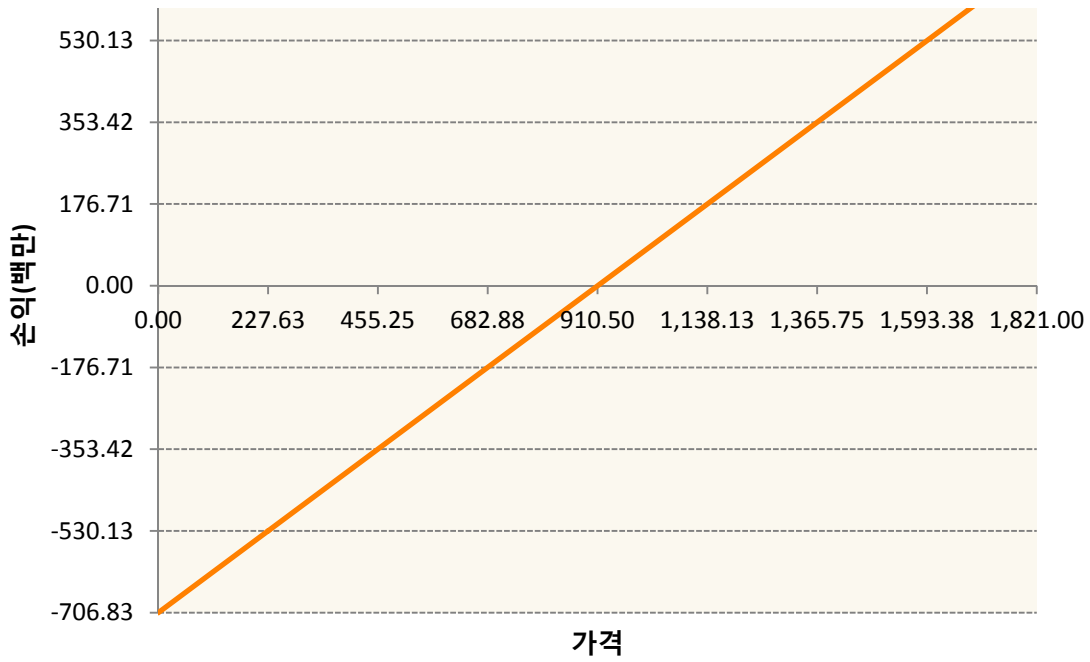


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	24
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CU8	CORN FUTURE SEP18	66
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	23
KR4175N70C	2018-07 달러선물	13

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	29
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	33
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	57
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	40

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

310